

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63, 1000-300 LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2019-10-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
COMPOSIÇÃO DISCRIMINADA CARTEIRA						
VALORES MOBILIÁRIOS COTADOS						
MERC. COT. OFICIAIS DE BOLSA VAL. PORT.					39	38 076
Obrigações diversas						
RENEPL Float 20	20 000	100.61%	EUR	100.61%	39	20 160
Ações						
EDP Renováveis	1 753	10.22	EUR	10.22		17 916
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					23 405	13 769 492
Títulos de Dívida Pública						
DBR 2.5% 01/2021	200 000	103.81%	EUR	103.81%	4 123	211 751
DBR 1.5% 02/2023	318 000	107.30%	EUR	107.30%	3 385	344 599
DBR 1.25% 08/48	47 000	133.32%	EUR	133.32%	125	62 787
FRTR 4.25% 10/2023	360 000	119.48%	EUR	119.48%	293	430 435
FRTR 0.25% 11/26	800 000	104.20%	EUR	104.20%	1 868	835 436
SPGB 1.95% 07/2030	20 000	117.44%	EUR	117.44%	100	23 588
SPGB 3.45% 07/66	100 000	166.85%	EUR	166.85%	886	167 733
SPGB 0.45% 10/22	966 000	102.49%	EUR	102.49%	12	990 036
BTPS 4% 2/2037	565 000	136.18%	EUR	136.18%	5 650	775 067
BTPS 2% 12/2025	200 000	108.96%	EUR	108.96%	1 672	219 582
BOTS 0% 12/2019	300 000	99.70%	EUR	99.70%	979	300 089
T 2.515% 01/2020	125 000	97.75%	USD	97.75%	1 945	111 507
NETHER 0.75% 07/28	200 000	109.66%	EUR	109.66%	447	219 761
RAGB 0% 07/2023	300 000	102.04%	EUR	102.04%		306 123
IRISH 0% 10/22	200 000	101.45%	EUR	101.45%		202 896
CHILE 0.83% 07/2031	100 000	102.05%	EUR	102.05%	277	102 323
CCTS Float 11/19	100 000	99.99%	EUR	99.99%	458	100 446
						5 404 159
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
BERGER Float 10/22	50 000	101.24%	EUR	101.24%		50 622
KFW 0% 04/2024	250 000	101.85%	EUR	101.85%		254 635
						305 257
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	200 000	99.46%	EUR	99.46%	4	198 916
SAPGR Float 03/21	200 000	100.22%	EUR	100.22%		200 444
VW Float 12/21	200 000	100.46%	EUR	100.46%	76	201 004
CMZB Float 12/20	100 000	100.34%	EUR	100.34%	2	100 343
DB Float 12/2020	200 000	99.49%	EUR	99.49%	17	199 003
BNP Float 09/22	100 000	101.35%	EUR	101.35%	49	101 398
SOCGEN Float 04/22	100 000	101.03%	EUR	101.03%	38	101 065
ACAFP Float 04/22	100 000	101.08%	EUR	101.08%	12	101 094
RENAUL Float 03/2022	100 000	100.00%	EUR	100.00%	30	100 033
GFCFP Float 06/22	100 000	100.14%	EUR	100.14%		100 143
RENAULT Float 11/24	50 000	96.84%	EUR	96.84%	24	48 446
ALDFP Float 11/20	100 000	100.21%	EUR	100.21%	3	100 213
CAFP Float 06/22	100 000	100.24%	EUR	100.24%	24	100 267
ACAFP Float 01/2022	100 000	100.73%	EUR	100.73%	6	100 737
HSBC Float 09/22	100 000	100.55%	EUR	100.55%	28	100 582
HSBC Float 10/23	100 000	100.00%	EUR	100.00%	5	100 006
RBS Float 09/21	100 000	100.82%	EUR	100.82%	48	100 865
AMSSM Float 03/22	200 000	100.14%	EUR	100.14%	14	200 290

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63, 1000-300 LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2019-10-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
SCANIA Float 04/20	100 000	100.07%	EUR	100.07%		100 072
FCABNK Float 06/21	100 000	99.87%	EUR	99.87%		99 874
ISPIM Float 02/2021	100 000	100.66%	EUR	100.66%	120	100 776
WFC Float 01/22	100 000	100.32%	EUR	100.32%	0	100 324
BAC Float 05/23	100 000	100.80%	EUR	100.80%	99	100 903
GM Float 05/21	200 000	100.13%	EUR	100.13%	127	200 393
BAC FLOAT 04/24	100 000	100.53%	EUR	100.53%	6	100 533
MS Float 05/21	100 000	100.10%	EUR	100.10%		100 100
T Float 09/23	200 000	101.37%	EUR	101.37%	133	202 879
NDASS Float 09/21	100 000	100.67%	EUR	100.67%	9	100 675
MYL Float 05/20	100 000	99.95%	EUR	99.95%	16	99 968
BAYNGR Float 06/22	200 000	100.11%	EUR	100.11%	29	200 243
INTNED Float 09/23	100 000	101.38%	EUR	101.38%	53	101 434
BMW Float 01/2021	100 000	100.26%	EUR	100.26%	3	100 263
INTNED Float 04/22	100 000	100.53%	EUR	100.53%		100 528
ANNGR Float 12/2022	200 000	99.91%	EUR	99.91%	12	199 838
JYBC Float 12/22	100 000	100.72%	EUR	100.72%	29	100 749
CBSBKF Float 03/21	100 000	100.18%	EUR	100.18%	9	100 191
KBCBB Float 11/22	100 000	100.68%	EUR	100.68%	25	100 701
DLTAS 2008-1 A	53 908	99.81%	EUR	99.81%	2	53 807
DHR Float 06/22	100 000	99.92%	EUR	99.92%		99 919
SUMIBK Float 06/22	200 000	100.31%	EUR	100.31%	13	200 627
BMO Float 03/22	100 000	100.64%	EUR	100.64%	9	100 651
CAFP Float 03/2020	100 000	100.07%	EUR	100.07%	15	100 080
SANTAN Float 03/2020	100 000	100.16%	EUR	100.16%	26	100 187
UPS Float 07/2020	100 000	100.21%	EUR	100.21%	1	100 209
DE Float 04/20	100 000	100.11%	EUR	100.11%		100 112
GS Float 07/2022	75 000	101.76%	EUR	101.76%	5	76 326
GS Float 29/05/2020	85 000	100.30%	EUR	100.30%	43	85 300
SAPGR Float 04/2020	65 000	100.08%	EUR	100.08%		65 049
MMM Float 05/20	100 000	100.16%	EUR	100.16%		100 160
WFC Float 04/21	100 000	100.68%	EUR	100.68%	2	100 685
ARRFP Float 01/2020	100 000	100.09%	EUR	100.09%	22	100 113
GE FLOAT 5/21	100 000	99.51%	EUR	99.51%		99 508
RABOBK Float 05/2020	150 000	100.20%	EUR	100.20%		150 296
GE Float 01/2020	100 000	99.91%	EUR	99.91%		99 907
						6 298 226
Ações						
BMW	207	68.71	EUR	68.71		14 223
SIEMENS	505	103.38	EUR	103.38		52 207
ALLIANZ	314	219.00	EUR	219.00		68 766
E.ON AG (EX VEBA AG)	1 154	9.04	EUR	9.04		10 429
BASF	314	68.23	EUR	68.23		21 424
BAYER AG	706	69.58	EUR	69.58		49 123
ADIDAS- SALOMON AG	111	276.85	EUR	276.85		30 730
SAP SE	503	118.80	EUR	118.80		59 756
DEUTSCHE TELEKOM	1 171	15.77	EUR	15.77		18 464
DAIMLER CHRYSLER	531	52.41	EUR	52.41		27 830
DEUTSCHE POST	668	31.75	EUR	31.75		21 209
PORSCHE AG-PFD	141	66.00	EUR	66.00		9 306
VOLKSWAGEN AG-PREF.	127	170.70	EUR	170.70		21 679

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63, 1000-300 LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2019-10-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
CONTINENTAL AG	61	119.88	EUR	119.88		7 313
FRESENIUS SE&CO KGAA	297	47.13	EUR	47.13		13 996
WIRECARD AG	158	113.55	EUR	113.55		17 941
COVESTRO AG	352	43.05	EUR	43.05		15 154
SIEMENS HEALTHIN	338	38.10	EUR	38.10		12 876
DANONE	482	74.36	EUR	74.36		35 842
AXA-UAP	286	23.69	EUR	23.69		6 774
PERNOD RICARD	162	165.50	EUR	165.50		26 811
TOTAL SA	920	47.14	EUR	47.14		43 364
L OREAL	165	261.80	EUR	261.80		43 197
Kering	44	510.20	EUR	510.20		22 449
BNP	1 221	46.81	EUR	46.81		57 155
AIR LIQUIDE	88	119.10	EUR	119.10		10 481
SCHNEIDER	364	83.26	EUR	83.26		30 307
L.V.M.H.	164	382.50	EUR	382.50		62 730
MICHELIN	94	109.10	EUR	109.10		10 255
SAINT-GOBAIN	375	36.47	EUR	36.47		13 676
THOMSON	84	87.64	EUR	87.64		7 362
RENAULT SA	132	45.76	EUR	45.76		6 040
EssilorLuxottica	155	136.80	EUR	136.80		21 204
ORANGE	2 356	14.44	EUR	14.44		34 021
GLE ENTREP. VINCI	389	100.60	EUR	100.60		39 133
SANOFI SYNHLABO	515	82.62	EUR	82.62		42 549
AIRBUS SE	324	128.42	EUR	128.42		41 608
CREDIT AGRICOLE SA	2 594	11.69	EUR	11.69		30 311
SAFRAN SA	217	141.85	EUR	141.85		30 781
HERMES INTERNACIONAL	16	645.00	EUR	645.00		10 320
AMUNDI SA	423	64.00	EUR	64.00		27 072
RECKITT BENCKISER	164	59.64	GBP	69.24		11 355
ANGLO AMERICAN PLC	566	19.82	GBP	23.00		13 020
OCADO GROUP PLC	1 089	13.29	GBP	15.43		16 801
INFORMA PLC	1 307	7.75	GBP	9.00		11 759
TELEFONICA	1 390	6.88	EUR	6.88		9 556
BCO SANTANDER C.HISP	6 260	3.59	EUR	3.59		22 498
IBERDROLA	2 465	9.21	EUR	9.21		22 698
REPSOL	1 263	14.70	EUR	14.70		18 566
INDITEX	678	27.95	EUR	27.95		18 950
Aena SME SA	62	164.50	EUR	164.50		10 199
MASMOVIL IBERCOM	690	20.72	EUR	20.72		14 297
TELECOM ITALIA	23 272	0.52	EUR	0.52		12 211
UNICREDITO ITALIANO	2 970	11.37	EUR	11.37		33 763
BANCA INTESA	4 063	2.25	EUR	2.25		9 126
ENEL	3 460	6.94	EUR	6.94		24 012
ATLANTIA SPA	383	22.14	EUR	22.14		8 480
MEDIOLANUM SPA	2 320	7.69	EUR	7.69		17 829
INVESTOR AB	540	494.50	SEK	46.00		24 840
ESSITY AKTIEBO-B	459	301.30	SEK	28.03		12 865
ING GROEP NV	1 766	10.13	EUR	10.13		17 886
KONINKLIJKE KPN	3 981	2.78	EUR	2.78		11 067
ASML NA	314	235.00	EUR	235.00		73 790
AKZO NOBEL NV NLG20	282	82.55	EUR	82.55		23 279

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63, 1000-300 LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2019-10-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
DSM NV	252	106.25	EUR	106.25		26 775
FIAT CHRYSLER AUTOM	627	13.93	EUR	13.93		8 733
EURONEXT NV	255	72.25	EUR	72.25		18 424
UNILEVER NV	1 321	52.95	EUR	52.95		69 947
NOKIA A	5 664	3.29	EUR	3.29		18 654
Neste Oyj	827	32.36	EUR	32.36		26 762
KONE OYJ-B	236	57.04	EUR	57.04		13 461
CRH ORD	440	32.68	EUR	32.68		14 379
						1 761 851
MERC.COT.OFIC. DE B.V. DE ESTADOS NÃO EU					168	301 535
Obrigações diversas						
F Float 05/21	100 000	98.96%	EUR	98.96%	7	98 962
TACHEM Float 11/22	100 000	102.04%	EUR	102.04%	136	102 177
TACHEM Float 11/20	100 000	100.37%	EUR	100.37%	26	100 397
						301 535
						14 109 103
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL						3 244 736
CXG IMOBILIARIO	182 714	4.01	EUR	4.01		731 989
CAIXA PRIVATE EQUITY	16 936	5.47	EUR	5.47		92 611
CXG INFRAESTRUTURAS	23 442	7.73	EUR	7.73		181 101
FUNDIESTAMO I	58	1 139.48	EUR	1 139.48		66 090
Fundimo	274 060	7.64	EUR	7.64		2 094 531
Fnd I.Imob. MAXIRENT	7 207	10.88	EUR	10.88		78 414
OIC DOMICILIADOS NUM ESTADO-MEMBRO DA EU						9 438 583
ALLIANZ EUOLD EQY G	226	2 665.68	EUR	2 665.68		602 444
JANUS HEND H. PAN AL	1 764	16.70	EUR	16.70		29 459
SCHRODER ISF EURO EQ	40 002	44.69	EUR	44.69		1 787 881
MERRILL LYNCH MARSH	469	137.02	EUR	137.02		64 262
JAN HND UK ABS RET	9 278	7.06	EUR	7.06		65 517
MERIAN GLOBAL INVEST	26 555	1.41	EUR	1.41		37 551
SCH EUROP ALPHA ABS	431	95.49	EUR	95.49		41 157
LYXOR EPSILON GLOB E	281	132.77	EUR	132.77		37 308
ALLIANZ RCM EUR EQTY	625	1 883.09	EUR	1 883.09		1 176 931
AMUNDI CASH INST SRI	4	218 288.70	EUR	218 288.70		873 155
JANUS HEND HORIZ EUR	119 297	14.93	EUR	14.93		1 781 104
LFIS-VIS PR-M€A	112	1 045.03	EUR	1 045.03		117 043
DNCA INVEST-MIURA-I	181	115.44	EUR	115.44		20 895
MLIS PSAM GL EV UC A	380	135.20	EUR	135.20		51 399
AM-EURL EQ-I2EC	182 377	9.81	EUR	9.81		1 789 118
NORDEA 1-EUHY-BI-EUR	10 982	37.81	EUR	37.81		415 229
XUS TREASURY €	4 593	119.34	EUR	119.34		548 129
OIC DOMICI. EM ESTADOS NÃO MEMBROS DA EU						407 265
ISHARES TREASURY B	17 289	26.27	USD	23.56		407 265
						13 090 585
LIQUIDEZ						
À VISTA						1 364 298
Depósitos à ordem						
DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			408

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63, 1000-300 LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2019-10-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			139
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			1 351 123
DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			4 321
DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			41
DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			217
DO CGD - USD 0.0000%			USD			8 049
						1 364 298
						1 364 298
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
VALORES ACTIVOS						1 784
VALORES PASSIVOS						-29 559
						-27 775
						28 536 211
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					4 519 492.54	
Valor da Unidade de Participação: € 6.3140						